

# Relatório Analítico dos Investimentos

em outubro de 2023

## Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2023)

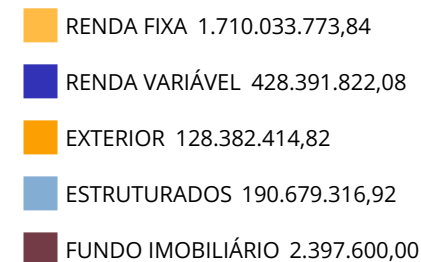
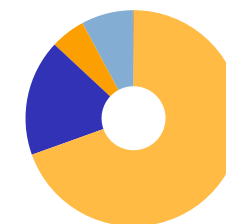
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			1.017.672.527,68	41,37%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	3.426.243,20	0,14%	140	1,81%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	D+0	15/08/2024	10.816.365,08	0,44%	92	5,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	88.081.315,64	3,58%	863	1,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	1.617,04	0,00%	15.103	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	472.819.663,95	19,22%	1.125	3,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	117.216.041,25	4,77%	386	2,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	42.826.002,86	1,74%	19.688	3,93%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	35.327.646,12	1,44%	27.006	4,50%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	34.551.867,61	1,40%	19.220	2,65%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	D+3	Não há	25.011.344,84	1,02%	47	9,54%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	58.975.032,41	2,40%	134	14,51%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	32.567.401,59	1,32%	978	5,58%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	37.235.133,91	1,51%	205	5,44%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	59.282.653,71	2,41%	90	14,93%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	48.089.013,08	1,95%	15.100	3,22%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	44.119.476,42	1,79%	35	10,54%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕ...	D+24	Não há	7.881.357,25	0,32%	17	5,53%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+33	Não há	937.657,07	0,04%	4.133	0,32%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.587.235,21	0,06%	152	1,14%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	31.153.003,36	1,27%	109	2,52%	Artigo 9º, Inciso II
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	26.154.999,94	1,06%	51	6,66%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO N...	D+12	Não há	11.074.280,23	0,45%	605	17,92%	Artigo 9º, Inciso II
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIO...	D+5 du	Não há	5.029.419,41	0,20%	73	8,93%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	27.289.728,40	1,11%	4.191	4,92%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	22.539.838,18	0,92%	473	1,16%	Artigo 9º, Inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	5.141.145,30	0,21%	357	0,82%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	94.269.065,33	3,83%	6.532	6,49%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	96.410.251,59	3,92%	612	8,54%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	2.397.600,00	0,10%		1,66%	Artigo 11º
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>2.459.884.927,66</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>16.956,42</b>	Artigo 6º			
<b>PL Total</b>			<b>2.459.901.884,08</b>				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Outubro / 2023)

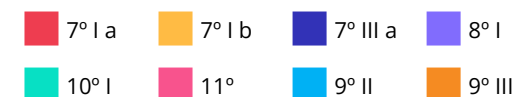
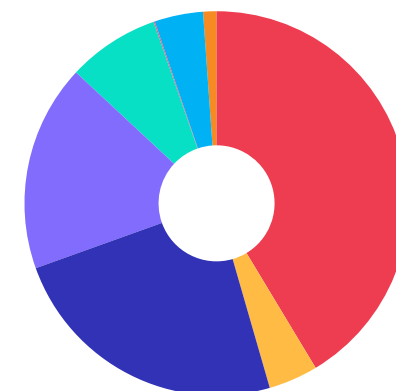
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	1.017.672.527,68	41,37%	10,00%	60,00%	100,00%	1.442.212.399,98
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	102.325.540,96	4,16%	0,00%	3,00%	90,00%	2.111.570.893,93
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	90,00%	2.213.896.434,89
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	590.035.705,20	23,99%	2,00%	3,00%	65,00%	1.008.889.497,78
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	65,00%	1.598.925.202,98
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	122.994.246,38
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>1.710.033.773,84</b>	<b>69,52%</b>	<b>12,00%</b>	<b>66,00%</b>	<b>415,00%</b>	



Enquadramento e Política de Investimento (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Outubro / 2023)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	428.391.822,08	17,42%	0,00%	18,20%	35,00%	432.567.902,60
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	35,00%	860.959.724,68
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	190.679.316,92	7,75%	0,00%	9,50%	10,00%	55.309.175,85
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	122.994.246,38
Artigo 11º	5,00%	2.397.600,00	0,10%	0,00%	0,30%	5,00%	120.596.646,38
<b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b>	<b>30,00%</b>	<b>621.468.739,00</b>	<b>25,26%</b>	<b>0,00%</b>	<b>28,00%</b>	<b>90,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	100.701.431,34	4,09%	0,00%	4,30%	10,00%	145.287.061,43
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	27.680.983,48	1,13%	0,00%	1,70%	10,00%	218.307.509,29
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>128.382.414,82</b>	<b>5,22%</b>	<b>0,00%</b>	<b>6,00%</b>	<b>20,00%</b>	



Enquadramento por Gestores - base (Outubro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	1.017.672.527,68	41,37	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	657.075.792,12	26,71	-
CAIXA DTVM	347.448.905,63	14,12	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	266.744.725,33	10,84	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	83.986.377,25	3,41	-
ITAÚ DTVM	52.000.833,67	2,11	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	27.289.728,40	1,11	-
BANCO J. SAFRA S/A	7.666.037,58	0,31	-

**Artigo 20º** - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	1.017.672.527,68	41,37	10,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	102.325.540,96	4,16	0,00	90,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	590.035.705,20	23,99	2,00	65,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	65,00
Artigo 8º, Inciso I	428.391.822,08	17,42	0,00	35,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	100.701.431,34	4,09	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	27.680.983,48	1,13	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	190.679.316,92	7,75	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	2.397.600,00	0,10	0,00	1,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	-0,41%	8,53%	0,64%	2,92%	9,03%	22,65%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,29%	8,48%	0,84%	3,19%	9,04%	22,01%	1,24%	0,02%

<b>CDI (Benchmark)</b>	1,00%	11,02%	3,14%	6,55%	13,42%	26,45%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,99%	10,95%	3,15%	6,60%	13,35%	26,71%	0,01%	0,00%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,78%	8,61%	2,46%	5,13%	10,46%	20,19%	0,00%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,06%	11,40%	3,45%	7,09%	13,86%	27,84%	0,04%	0,00%

<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,24%	3,75%	0,73%	1,00%	4,82%	11,60%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43%	9,26%	2,45%	4,48%	10,12%	23,93%	0,48%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	9,27%	2,45%	4,48%	10,14%	24,15%	0,47%	0,02%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	-1,57%	15,39%	-1,87%	6,65%	18,36%	-16,13%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,40%	14,42%	-2,16%	6,20%	16,47%	-17,58%	7,82%	0,21%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-2,94%	3,11%	-7,22%	8,34%	-2,49%	9,32%	-	-
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	-2,90%	2,86%	-7,08%	8,12%	-2,52%	9,32%	7,15%	0,18%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	-5,21%	-1,57%	-11,24%	4,08%	-12,29%	-6,68%	9,57%	0,19%
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	-2,96%	3,15%	-7,21%	8,35%	-2,38%	9,36%	7,29%	0,19%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-5,74%	5,39%	-9,05%	8,04%	-1,21%	13,64%	9,24%	0,19%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-3,69%	1,38%	-8,58%	6,96%	-5,89%	5,92%	7,60%	0,18%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	-4,55%	1,44%	-9,44%	6,22%	-8,50%	-8,27%	7,57%	0,19%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-5,29%	0,47%	-9,76%	7,47%	-10,82%	-1,56%	8,34%	0,19%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-4,29%	-8,30%	-9,21%	-1,31%	-14,60%	-4,03%	6,54%	0,17%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	-5,07%	-4,56%	-11,92%	3,40%	-10,62%	2,28%	8,24%	0,18%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-3,33%	-0,10%	-6,99%	6,49%	-11,81%	-11,85%	7,60%	0,20%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-2,90%	1,40%	-6,64%	8,29%	-5,16%	2,67%	6,99%	0,19%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	-5,10%	2,27%	-10,20%	7,01%	-9,66%	-9,44%	7,83%	0,20%
<b>IFIX (Benchmark)</b>	-1,97%	10,06%	-1,30%	10,41%	5,49%	17,94%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-2,01%	26,86%	-0,20%	26,58%	15,33%	12,60%	4,83%	0,23%



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI ACWI (Benchmark)	-2,10%	1,94%	-3,96%	-1,70%	4,45%	-23,43%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-1,77%	15,81%	-7,01%	4,37%	16,80%	7,09%	7,21%	0,16%

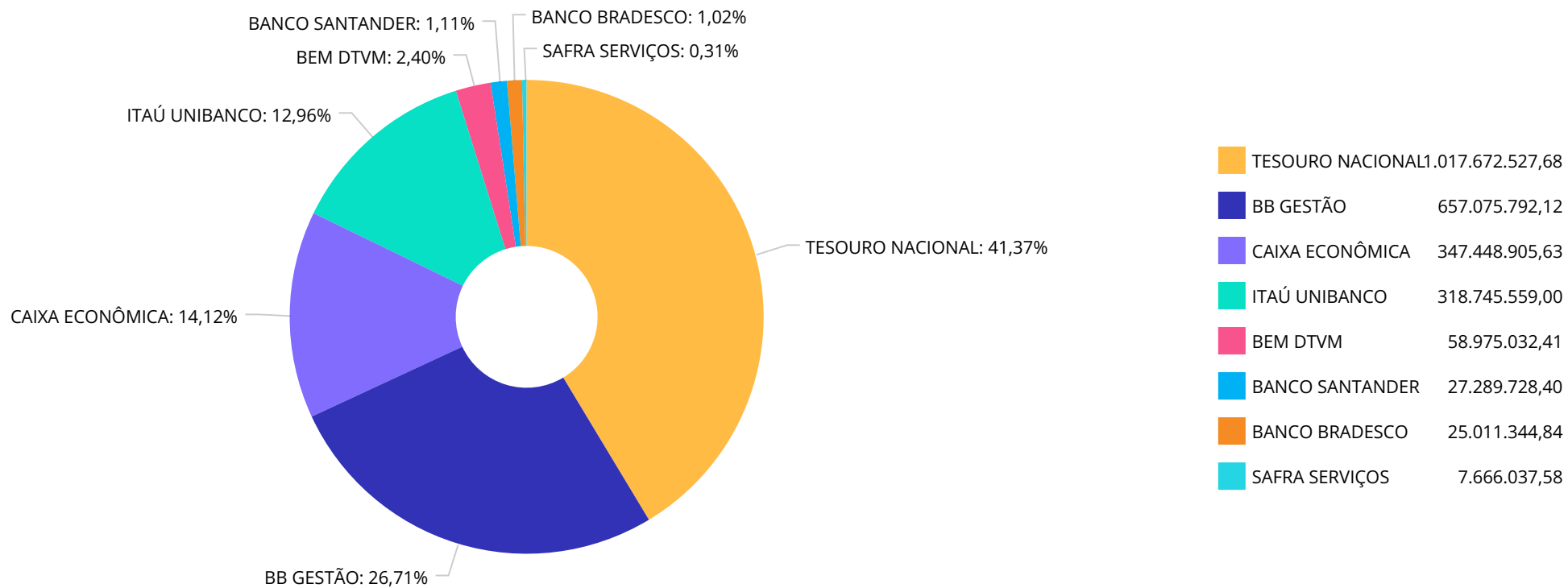
  

S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	-2,20%	9,23%	-8,61%	0,58%	8,31%	-8,94%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	-1,76%	11,72%	-7,05%	2,34%	12,61%	1,39%	7,02%	0,15%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-1,75%	15,73%	-7,00%	4,28%	16,83%	7,04%	7,19%	0,16%

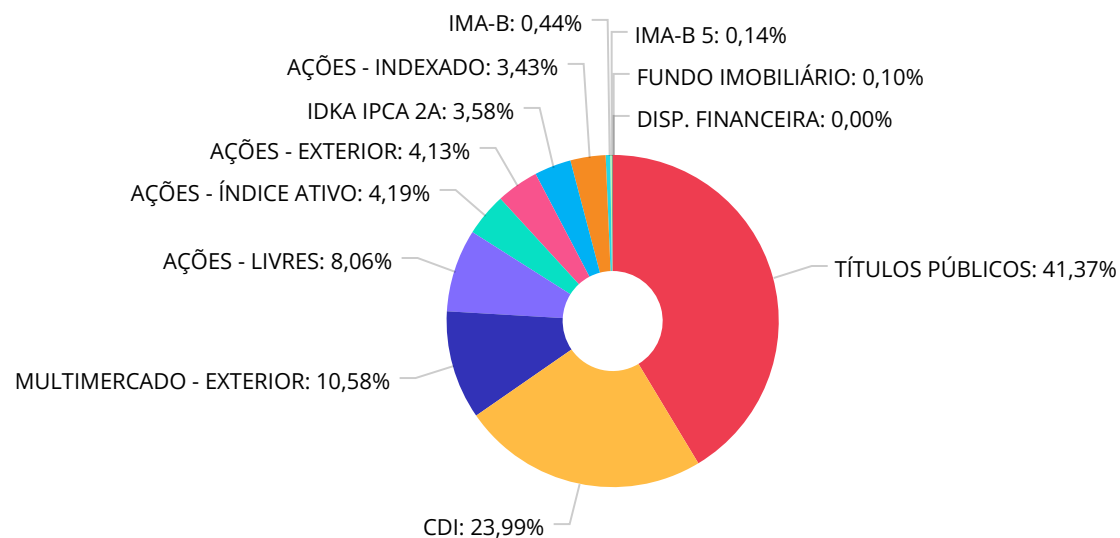
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	-1,57%	15,39%	-1,87%	6,65%	18,36%	-16,13%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-2,05%	7,80%	-1,21%	1,98%	9,50%	-22,21%	7,01%	19,352%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,40%	14,42%	-2,16%	6,20%	16,47%	-17,58%	7,82%	20,681%
<b>MSCI WORLD (Benchmark)</b>	-2,00%	3,11%	-3,63%	-1,26%	4,55%	-21,84%	-	-
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	-1,69%	5,39%	-0,97%	1,78%	12,32%	-12,20%	6,45%	18,765%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	-3,29%	-1,32%	-4,02%	-2,07%	3,46%	-27,37%	5,14%	16,424%
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-4,09%	-6,18%	-6,68%	-3,78%	8,48%	-30,10%	6,46%	16,998%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MU...	-2,75%	0,65%	-4,15%	-2,30%	5,98%	-32,90%	4,99%	17,631%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-5,05%	-8,80%	-7,85%	-8,28%	-3,22%	-28,66%	5,84%	18,345%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Outubro / 2023)



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Outubro / 2023)



■ TÍTULOS PÚBLICOS	1.017.672.527,68	■ CDI	590.037.322,24	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	260.196.328,91	■ AÇÕES - LIVRES	198.177.311,84
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	103.094.508,83	■ AÇÕES - EXTERIOR	101.691.405,69	■ IDKA IPCA 2A	88.081.315,64	■ AÇÕES - INDEXADO	84.293.998,55
■ IMA-B	10.816.365,08	■ IMA-B 5	3.426.243,20	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	2.397.600,00	■ DISP. FINANCEIRA	16.956,42

## Carteira de Títulos Públicos no mês de (Outubro / 2023)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	23/11/2022	3.761	3988,237004	4.183,768192	14.999.759,37	15.735.152,17	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	23/11/2022	1.254	3.988,237004	4.183,768192	5.001.249,20	5.246.445,31	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	28/11/2022	2.515	3977,260022	4.174,729202	10.002.808,96	10.499.443,94	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	28/11/2022	3.771	3.977,260022	4.174,729202	14.998.247,54	15.742.903,82	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/05/2023	9.712	4.118,503984	4.163,042931	39.998.910,69	40.431.472,94	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/06/2022	9.875	3.971,848591	4.208,100738	39.222.004,84	41.554.994,78	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	29/08/2022	7.642	3925,476529	4.185,883524	29.998.491,63	31.988.521,89	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	09/03/2022	10.335	3.855,205568	4.223,42754	39.843.549,55	43.649.123,62	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	07/07/2022	9.782	4089,215327	4.211,018149	40.000.704,33	41.192.179,53	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	11/07/2022	7.384	4062,955171	4.183,797283	30.000.860,98	30.893.159,13	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	16/09/2022	9.987	4004,964372	4.232,961077	39.997.579,18	42.274.582,27	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	25/02/2022	10.047	3.981,059981	4.357,34589	39.997.709,63	43.778.254,15	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	04/03/2022	15.090	3.904,253962	4.343,681431	58.915.192,29	65.546.152,79	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	29/06/2022	296	4047,135758	4.303,032989	1.197.952,18	1.273.697,76	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	07/07/2022	498	3.985,691744	4.262,899874	1.984.874,49	2.122.924,13	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	07/03/2022	10.178	3.916,536627	4.292,05737	39.862.509,79	43.684.559,91	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	08/03/2022	10.225	3.911,428571	4.270,288988	39.994.357,14	43.663.704,90	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	15/03/2022	3.890	3.876,160059	4.235,774592	15.078.262,63	16.477.163,16	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	25/02/2022	15.015	3.926,828179	4.377,875826	58.961.325,11	65.733.805,52	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	10/05/2022	2.400	4.016,527746	4.347,72508	9.639.666,59	10.434.540,19	Curva

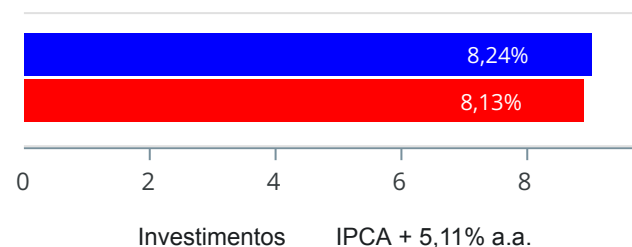
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Outubro / 2023)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	09/05/2022	4.840	4131,678715	4.352,728733	19.997.324,98	21.067.207,06	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	11/05/2022	2.310	4113,158402	4.327,793588	9.501.395,91	9.997.203,18	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	27/06/2022	223	4039,820802	4.303,070392	900.880,04	959.584,69	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	27/06/2022	520	4.013,452065	4.303,070392	2.086.995,07	2.237.596,60	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	11/05/2022	4.940	3.993,115642	4.260,580905	19.725.991,27	21.047.269,67	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	15/06/2022	9.790	4.007,081511	4.244,177736	39.229.327,99	41.550.500,03	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	06/02/2023	10.000	3.785,199052	3.960,037606	37.851.990,52	39.600.376,06	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	03/03/2023	10.479	3816,987204	3.960,037606	39.998.208,91	41.497.234,07	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	06/07/2022	5.050	3.929,948645	4.206,588005	19.846.240,66	21.243.269,42	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	06/03/2023	10.386	3851,268116	3.995,204472	39.999.270,65	41.494.193,64	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	29/06/2022	4.935	3.965,241251	4.188,007167	19.568.465,57	20.667.815,36	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	07/07/2022	5.024	3.888,609735	4.100,139873	19.536.375,31	20.599.102,72	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	23/11/2022	10.213	3.916,628783	4.082,938779	40.000.529,76	41.699.053,74	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	06/02/2023	10.327	3.760,654822	3.933,510768	38.836.282,35	40.621.365,70	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	03/03/2023	10.549	3792,196447	3.933,510768	40.003.880,32	41.494.605,09	Curva

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	2.228.676.184,81	156.376.748,48	133.604.967,93	2.300.984.841,17	49.536.875,81	49.536.875,81	2,20%	2,20%	0,97%	0,97%	227,21%	5,89%
Fevereiro	2.300.984.841,17	228.773.683,89	228.216.386,55	2.285.153.296,15	-16.388.842,36	33.148.033,45	-0,71%	1,47%	1,20%	2,18%	67,56%	5,13%
Março	2.285.153.296,15	169.763.712,54	159.464.712,55	2.313.038.391,41	17.586.095,27	50.734.128,72	0,77%	2,25%	1,17%	3,37%	66,68%	5,96%
Abril	2.313.038.391,41	55.915.092,17	39.403.674,98	2.352.917.925,44	23.368.116,84	74.102.245,56	1,00%	3,28%	0,97%	4,38%	74,86%	5,37%
Maio	2.352.917.925,44	438.719.161,85	427.333.355,28	2.401.513.041,85	37.209.309,84	111.311.555,40	1,57%	4,90%	0,67%	5,07%	96,63%	3,98%
Junho	2.401.513.041,85	50.802.600,00	38.447.144,74	2.471.521.037,72	57.652.540,61	168.964.096,01	2,39%	7,41%	0,34%	5,42%	136,53%	3,54%
Julho	2.471.521.037,72	48.416.570,48	42.713.570,48	2.513.079.886,22	35.855.848,50	204.819.944,51	1,45%	8,96%	0,54%	5,99%	149,59%	3,29%
Agosto	2.513.079.886,22	46.803.376,65	62.288.049,02	2.492.695.308,12	-4.899.905,73	199.920.038,78	-0,19%	8,75%	0,69%	6,72%	130,27%	3,34%
Setembro	2.492.695.308,12	39.635.307,60	47.101.023,91	2.484.306.350,49	-923.241,32	198.996.797,46	-0,04%	8,71%	0,66%	7,42%	117,42%	3,31%
Outubro	2.484.306.350,49	221.153.242,63	237.254.772,17	2.456.331.455,65	-11.873.365,30	187.123.432,16	-0,44%	8,24%	0,66%	8,13%	101,35%	3,86%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

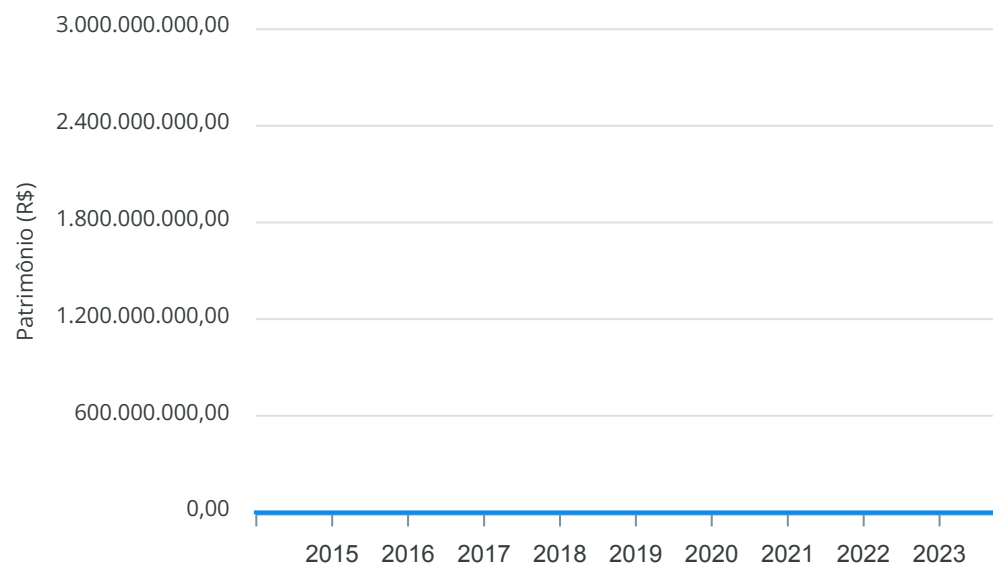


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

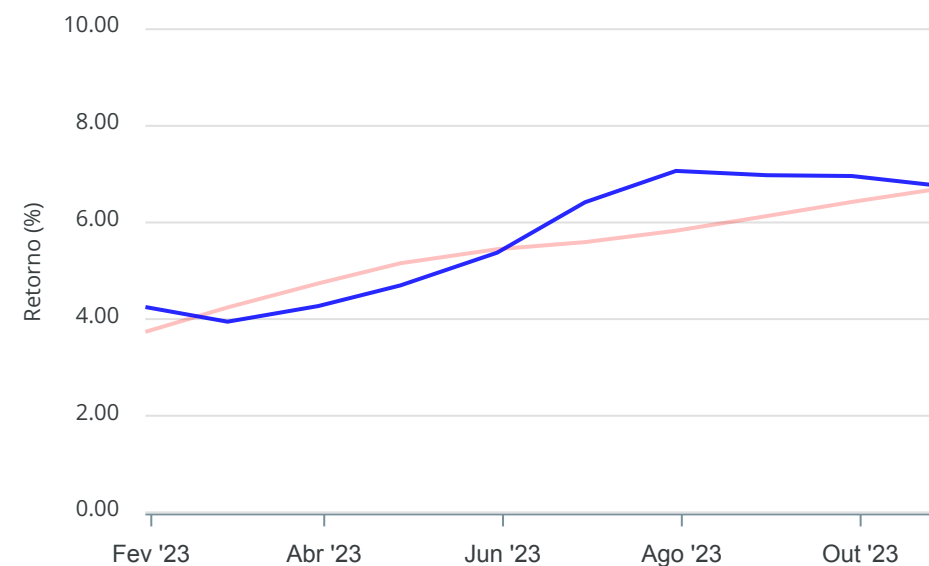
ANO

36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



Investimentos

Meta de Rentabilidade

☐ CDI

☐ IMA-B

☐ IMA-B 5

☐ IMA-B 5+

☐ IMA Geral

☐ IRF-M

☐ IRF-M 1

☐ IRF-M 1+

☐ Ibovespa

☐ IBX

☐ SMLL

☐ IDIV



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Outubro/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	115.984.133,15	0,00	0,00	117.216.041,25	1.231.908,10	1,06%	1,06%	0,04%
TÍTULOS PÚBLICOS	1.010.157.844,42	0,00	0,00	1.017.672.527,68	7.514.683,26	0,74%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	484.103.769,01	141.737.947,58	157.669.577,13	472.819.663,95	4.647.524,49	0,74%	0,99%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	3.413.170,66	0,00	0,00	3.426.243,20	13.072,54	0,38%	0,43%	0,47%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.775.309,25	0,00	0,00	10.816.365,08	41.055,83	0,38%	0,43%	0,48%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.225,31	1.025.946,43	1.025.946,43	1.617,04	391,73	0,04%	0,78%	0,00%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	88.321.582,54	79.165.348,62	79.147.948,61	88.081.315,64	-257.666,91	-0,15%	-0,29%	1,24%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.712.757.034,34</b>	<b>221.929.242,63</b>	<b>237.843.472,17</b>	<b>1.710.033.773,84</b>	<b>13.190.969,04</b>	<b>0,77%</b>		<b>0,18%</b>

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Outubro/2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	98.124.891,20	0,00	0,00	96.410.251,59	-1.714.639,61	-1,75%	-1,75%	7,19%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	95.969.309,84	0,00	0,00	94.269.065,33	-1.700.244,51	-1,77%	-1,77%	7,21%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.446.800,00	0,00	0,00	2.397.600,00	-49.200,00	-2,01%	-1,31%	4,83%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	43.749.096,65	0,00	0,00	42.826.002,86	-923.093,79	-2,11%	-1,76%	7,02%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	61.053.233,67	0,00	0,00	59.282.653,71	-1.770.579,96	-2,90%	-2,90%	7,15%
BRDESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	25.773.982,67	0,00	0,00	25.011.344,84	-762.637,83	-2,96%	-2,96%	7,29%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	35.694.248,98	0,00	0,00	34.551.867,61	-1.142.381,37	-3,20%	-2,90%	6,99%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	45.807.810,32	0,00	0,00	44.119.476,42	-1.688.333,90	-3,69%	-3,69%	7,60%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	36.709.886,62	0,00	0,00	35.327.646,12	-1.382.240,50	-3,77%	-3,33%	7,60%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	50.242.921,76	0,00	0,00	48.089.013,08	-2.153.908,68	-4,29%	-4,29%	6,54%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	1.662.919,08	0,00	0,00	1.587.235,21	-75.683,87	-4,55%	-4,55%	7,57%
BRDESCO SELECTION FIC AÇÕES	62.123.671,76	0,00	0,00	58.975.032,41	-3.148.639,35	-5,07%	-5,07%	8,24%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	988.075,51	0,00	0,00	937.657,07	-50.418,44	-5,10%	-5,10%	7,83%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	8.314.216,47	0,00	0,00	7.881.357,25	-432.859,22	-5,21%	-5,21%	9,57%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	34.385.316,18	0,00	0,00	32.567.401,59	-1.817.914,59	-5,29%	-5,77%	8,34%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	39.500.348,57	0,00	0,00	37.235.133,91	-2.265.214,66	-5,73%	-5,73%	9,24%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>642.546.729,28</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>621.468.739,00</b>	<b>-21.077.990,28</b>	<b>-3,28%</b>		<b>7,48%</b>

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Outubro / 2023)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	22.859.679,78	0,00	0,00	22.539.838,18	-319.841,60	-1,40%	-1,40%	7,82%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	31.674.559,84	0,00	0,00	31.153.003,36	-521.556,48	-1,65%	-1,69%	6,45%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5.248.912,99	0,00	0,00	5.141.145,30	-107.767,69	-2,05%	-2,05%	7,01%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ...	11.386.977,38	0,00	0,00	11.074.280,23	-312.697,15	-2,75%	-3,38%	4,99%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	28.218.637,86	0,00	0,00	27.289.728,40	-928.909,46	-3,29%	-3,29%	5,14%
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	5.244.139,01	0,00	0,00	5.029.419,41	-214.719,60	-4,09%	-4,09%	6,46%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	27.701.524,89	0,00	0,00	26.154.999,94	-1.546.524,95	-5,58%	-5,05%	5,84%
<b>Total Exterior</b>	<b>132.334.431,75</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>128.382.414,82</b>	<b>-3.952.016,93</b>	<b>-2,99%</b>		<b>6,18%</b>

#### Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

